

Central Daily Market Report

2025年8月6日(水)

セントラル短資株式会社 総合企画部

●資金需給

単位: 億円	2025年8月6日 需給速報	2025年8月7日 需給予想	2025年8月8日 当社予想			
銀行券	0	▲ 800	▲ 500			
財政	▲ 26,000	3,600	▲ 7,000			
資金過不足	▲ 26,000	2,800	▲ 7,500			
金融調節	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド
貸出						
全店共通	8,000	▲ 8,000				
国債買現						
国債売現						
国庫短期証買入			8,800			
国債買入						
CP等買入						
貸出支援基金(成)						
貸出支援基金(貸)						
被災地支援						
社債等買入						
気候変動対応オペ						
E T F買入						
国債補完供給	▲ 1,400	2,800	1,400			
当預増減	▲ 24,600	13,000	▲ 7,500			
当座預金残高	5,179,800	5,192,800	5,185,300			
準備預金残高	4,701,900					
積み終了先	4,701,800			8月7日以降の残り所要積立額		
超過準備	4,701,800			積数	200	
非準備預金先	477,900			1日平均	0	
積み期間(7/16~8/15日)の所要準備額(積数)					4,121,200	
準備預金進捗率	実績	100.00%	日数	70.97%		

●2025年8月6日の市場動向

<無担保コール市場>

本日の無担保コールO/N物は、引き続き幅広い業態から堅調な資金調達ニーズが見られ、出合いの水準は0.475~0.477%程度で推移した。ターム物は、ショートタームを中心に引き合いが見られた。

<レポ市場>

GC T/Nは、0.49~0.50%程度での出合いとなった。SCIは、ロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。

<短国市場>

6日のアウトライト市場は、1Y物で出合いが見られた。

<CP市場>

CP発行市場は複数の発行が観測された。発行レートは概ね横ばい圏での推移となった。

●短期金融市場関連指標

8/6	無担保コール(速報)						短国		東京レポレート		JGB新発10年債(%)		日経平均株価(円)		為替(ドル/円)	
単位: %	最低	最高	平均	最低	最高	平均	最低	最高	平均	直近値	前日比	終値	前日比	9時	17時	
O/N	0.450	0.525	0.477	1W	0.481	0.484	0.483	T+0	0.492	1.495	+0.025	40,794.86	+245.32	147.52-54	147.55-57	
T/N				2W	0.478	0.481	0.478	T+1	0.489							
S/N				3W												
2日				1M			0.600	1W	0.482							
3日				2M				2W	0.482							
4日				3M				3W	0.481							
5日				4M				1M	0.483							
6日			0.630	5M				3M	0.496							
有担保コール(速報)				6M				6M	0.529							
O/N			0.430	1Y				1Y	0.609							

日付	7/30	7/31	8/1	8/4	8/5
日銀当預残	5,250,100	5,244,900	5,263,900	5,200,600	5,204,400
準備預金残	4,773,000	4,746,500	4,777,900	4,719,100	4,710,000
マネタリーベース	6,468,300	6,463,600	6,482,900	6,419,500	6,422,700
無担O/N加重平均	0.481%	0.478%	0.477%	0.476%	0.477%
コール市場残高	115,905	109,471	113,380	110,177	113,285
うち無担	84,838	80,651	79,237	79,103	82,139
うちO/N	33,916	32,439	29,795	29,251	32,423
うち有担	31,067	28,820	34,143	31,074	31,146

●入札結果

名称	回号	表面利率	発行予定額	発行日	償還日	応募額(億円)	募入額(億円)	募入最低額	募入最高利回	案分率	募入平均価格	募入平均利回	第1非価格競争入札(億円)	第1非価格競争入札(億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。														

●オペ結果

種類	オファー額(億円・百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付利率(%)	応札総額(億円・百万ドル)	落札総額(億円・百万ドル)	按分レート・利回較差・価格較差	全取レート・利回較差・価格較差	平均落札レート・利回較差・価格較差	按分比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2025/8/7			2,832	1,000	0.019		0.020	87.6
国債買入(残存期間1年超3年以下)	3,250	2025/8/7			7,242	3,253	0.011		0.012	19.7
国債買入(残存期間3年超5年以下)	3,250	2025/8/7			9,683	3,254	0.014		0.014	82.5
国債買入(残存期間10年超25年以下)	1,350	2025/8/7			5,168	1,352	▲0.008		▲0.004	25.5
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)		2025/8/6	2025/8/7	0.250	1,551	1,551		0.250	0.250	
国債補完供給(国債売現先)・即日(午後オファー分)		2025/8/6	2025/8/7	0.250	0	0				

●2025年8月7日の予定

*7月のマネタリーベースと日本銀行の取引	*英中銀MPC	*国庫短期証券(1323回)入札(6ヶ月、35,000億円、8/12発行)	*エネルギー対策特別会計借入(3,028億円、8/20借入)
*6月の景気動向指数速報	*6月の米卸売売上高	*30年利付国債入札(7,000億円、8/8発行)	
	*6月の米消費者信用残高		

◆本資料は信頼できるとされる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。
◆本資料は何らかの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。
◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くことがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。
セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入